

浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型  
基金中基金（FOF）  
清算报告

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024 年 12 月 16 日

清算报告送出日：2024 年 12 月 30 日

## § 1 重要提示

浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2023〕1146 号《关于准予浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，于 2024 年 2 月 6 日成立并正式运作。

为顺应市场环境变化，保护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关约定，本基金管理人经与本基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，提议终止《浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据基金管理人 2024 年 11 月 19 日公告的《关于浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议生效公告》”），本次基金份额持有人大会于 2024 年 11 月 18 日表决通过了《关于终止浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》，本基金最后运作日为 2024 年 11 月 19 日，自 2024 年 11 月 20 日进入清算期。

基金管理人浦银安盛基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2024 年 11 月 20 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## § 2 基金产品概况

基金名称	浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基
------	-------------------------

	金（FOF）	
基金简称	浦银安盛招睿精选 3 个月持有混合（FOF）	
基金主代码	018712	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 2 月 6 日	
报告期末（2024 年 11 月 19 日）基金份额总额	4,350,592.10 份	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛招睿精选 3 个月持有混合（FOF）A	浦银安盛招睿精选 3 个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	018712	018713
报告期末（2024 年 11 月 19 日）下属分级基金的份额总额	229,137.99 份	4,121,454.11 份
投资目标	本基金将运用主动资产配置和优选基金的投资方法进行投资，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金结合大类资产配置和基金优选模型，精选风险收益比较好的基金构建基金投资组合，从而争取实现基金资产在长时间内保值增值的目的。通过对全球、国内的宏观经济、金融市场的深入研究，形成对权益、固收等各大类资产的投资观点，进一步应用资产配置的量化模型（Black-Litterman 模型）确定其组合权重，实现基金资产在大类资产间的有效配置。同时，通过自主开发的量化基金优选模型来筛选基金，获取资产轮动的 Beta 收益以及资产内部的 Alpha 收益，最终争取实现基金资产在长时间内保值增值的目的。	

业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×90%+中债综合全价（总值）指数收益率×10%
风险收益特征	本基金作为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金、货币型基金中基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

### § 3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可（2023）1146 号文准予注册，由基金管理人浦银安盛基金管理有限公司依照法律法规的规定和《浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的约定于 2023 年 11 月 20 日至 2024 年 2 月 2 日向社会公开发行募集，《基金合同》于 2024 年 2 月 6 生效。《基金合同》生效日的基金总份额为 279,202,828.14 份。

自本基金《基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

为顺应市场环境变化，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关约定，经与本基金托管人协商一致，提议终止《浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据基金管理人 2024 年 11 月 19 日公告的《关于浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2024 年 11 月 18 日表决通过了《关于终止浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》，本基金最后运作日为 2024 年 11 月 19 日，自 2024 年 11 月 20 日进入清算期。

## § 4 财务报告

## 4.1 资产负债表（经审计）

会计主体：浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2024 年 11 月 19 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2024 年 11 月 19 日
资 产：	
货币资金	305,684.94
结算备付金	581.80
存出保证金	8,024.64
交易性金融资产	2,795,550.30
其中：基金投资	2,795,550.30
应收清算款	1,379,899.65
资产总计	4,489,741.33
负 债 和 净 资 产	最后运作日 2024 年 11 月 19 日
负 债：	
应付赎回款	5.97
应付管理人报酬	2,099.71
应付托管费	479.68
应付销售服务费	795.43
应交税费	1,795.79
其他负债	92,121.68
负债合计	97,298.26
净 资 产：	
实收基金	4,350,592.10
未分配利润	41,850.97
净资产合计	4,392,443.07
负债和净资产总计	4,489,741.33

注：1、本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于本基金最后运作日，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质

所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

2、报告截止日 2024 年 11 月 19 日（基金最后运作日），基金份额总额 4,350,592.10 份，其中浦银安盛招睿精选 3 个月持有混合（FOF）A 类基金份额净值 1.0121 元，基金份额 229,137.99 份；浦银安盛招睿精选 3 个月持有混合（FOF）C 类基金份额净值 1.0095 元，基金份额 4,121,454.11 份。

3、本财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师王国蓓、欧梦澍签字出具了毕马威华振审字第 2414805 号标准无保留意见的审计报告。

## § 5 清算情况

自 2024 年 11 月 20 日至 2024 年 12 月 16 日止（即清算期间），基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

### 5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日银行存款余额为人民币 305,684.94 元，其中活期存款人民币 305,386.71 元，应计活期存款利息人民币 298.23 元。清算期间活期存款收支净额为人民币 4,175,475.80 元，计提活期存款利息人民币 1,126.80 元。于清算结束日银行存款余额为人民币 4,482,287.54 元，其中活期存款人民币 4,480,862.51 元，应计活期存款利息人民币 1,425.03 元。本基金最后运作日的应收利息中未结息的部分和自 2024 年 11 月 20 日本基金进入清算程序起至基金财产返还投资人前一日止期间本基金银行存款、结算备付金及存出保证金产生的利息收入，将由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司先行垫付，待实际结息资金到账后再归还本基金的基金管理人，与之前预估数所产生的差异也由本基金的基金管理人承担，本基金的基金管理人垫付资金孳生的利息归本基金的基金管理人所有。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 581.80 元，其中上海最低结算备付金人民币 564.16 元，应计上海最低结算备付金利息人民币 16.44 元，

应计深圳最低结算备付金利息人民币 1.20 元。上述上海最低结算备付金在清算期间调整入银行托管户人民币 564.16 元，计提上海最低结算备付金利息收入人民币 0.57 元，于清算结束日结算备付金余额为人民币 18.21 元，其中应计上海最低结算备付金利息人民币 17.01 元，应计深圳最低结算备付金利息人民币 1.20 元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 8,024.64 元，其中上海存出保证金人民币 7,803.78 元，应计上海存出保证金账户利息人民币 23.98 元，深圳存出保证金人民币 196.46 元，应计深圳存出保证金利息人民币 0.42 元，上述上海存出保证金在清算期间调整入银行托管户人民币 7,803.78 元，计提上海存出保证金利息收入人民币 4.55 元，深圳存出保证金在清算期间调整入银行托管户人民币 196.46 元，计提深圳存出保证金利息收入人民币 0.13 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 29.08 元，其中应计上海存出保证金利息人民币 28.53 元，应计深圳存出保证金利息人民币 0.55 元。

5.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产余额为人民币 2,795,550.30 元，均为基金投资，均于清算期间处置变现，于清算结束日交易性金融资产余额为人民币 0.00 元。

5.1.5 本基金最后运作日应收清算款余额为人民币 1,379,899.65 元，于清算期间确认应收清算款人民币 2,792,446.71 元，收回清算款人民币 4,172,346.36 元，于清算结束日应收清算款余额为人民币 0.00 元。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 5.97 元，于清算期间确认应付赎回款人民币 213.38 元，支付赎回款人民币 219.35 元，于清算结束日应付赎回款余额为人民币 0.00 元。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬余额为人民币 2,099.71 元，于清算期间支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为人民币 0.00 元。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 479.68 元，于清算期间支付，于清算结束日应付托管费余额为人民币 0.00 元。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 795.43 元，于清算期间支付，于清算结束日应付销售服务费余额为人民币 0.00 元。

5.2.5 本基金最后运作日应交税费余额为人民币 1,795.79 元，于清算期间支付，于清算结束日应交税费余额为人民币 0.00 元。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债余额为人民币 92,121.68 元，包括预提信息披露费人民币 77,091.68 元，预提审计费人民币 15,000.00 元，应付银行汇划手续费人民币 30.00 元，于清算期间计提银行汇划手续费人民币 30.00 元，支付银行汇划手续费人民币 30.00 元，计提应付赎回费人民币 0.02 元，支付赎回费人民币 0.02 元，于清算结束日其他负债余额为人民币 92,121.68 元。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2024 年 11 月 20 日 至 2024 年 12 月 16 日 止清算期间
一、收入	1,137.10
1、利息收入	1,132.05
2、投资收益（损失以“-”填列）	-21,253.29
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	21,258.31
4、其他收入	0.03
二、费用	3,153.59
1、交易费用	3,103.59
2、其他费用	50.00
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-2,016.49

### 5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 11 月 19 日基金净资产	4,392,443.07
加：清算期间净收益	-2,016.49
减：清算期间支付赎回款（含费用）	213.43
二、2024 年 12 月 16 日基金净资产	4,390,213.15

根据本基金的基金合同及《关于浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的约定，将基



金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。自本次清算期结束日次日至基金财产返还投资人前一日利息归基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由基金份额持有人承担。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

### 5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规的规定及《基金合同》的约定及时进行分配。

## § 6 备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

- 1、浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）清算财务报表及审计报告
- 2、上海市通力律师事务所关于《浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）清算报告》的法律意见

### 6.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 基金管理人的办公场所。

### 6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

清算报告出具日：2024 年 12 月 16 日

清算报告公告日：2024 年 12 月 30 日